



2022年7月期 (2021年7月9日～2022年7月8日) 決算短信
 Earnings Report for Fiscal Year ended July 2022 (July 9, 2021 - July 8, 2022)

2022年8月17日
 August 17, 2022

上場取引所 東証
 Listed Exchange TSE

ファンド名 NEXT FUNDS 日経225連動型上場投信
 コード番号 (1321)
 連動対象指標 日経平均株価(日経225)
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO 兼代表取締役社長 小池 広靖
 問合せ先責任者 サポートダイヤル 長坂 智 TEL 0120-753104

Fund name: NEXT FUNDS Nikkei 225 Exchange Traded Fund
 Code: 1321
 Underlying index: Nikkei Stock Average(Nikkei 225)
 Primary invested assets: Stocks
 Trading unit: 1 unit
 Management co.: Nomura Asset Management Co., Ltd. URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 Representative: Hiroyasu Koike, President & CEO
 Contact person: Satoshi Nagasaka, Head of Support Dial Team

有価証券報告書提出予定日 2022年9月28日
 分配金支払開始日 2022年8月16日
 Scheduled date of submission of securities report: September 28, 2022
 Date of commencing dividend payment: August 16, 2022

I ファンドの運用状況

Fund Management

1. 2022年7月期の運用状況 (2021年7月9日～2022年7月8日)

Management Status for Year ended July 2022 (from July 9, 2021 to July 8, 2022)

(1) 資産内訳 (百万円未満切捨て)

Assets (fractions of less than JPY mil. shall be rounded down)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計 (純資産)	
	Primary Invested Assets		Cash/Deposits/Other Assets (excluding liabilities)		Total (Net Assets)	
	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio	金額 Amount	構成比 ratio
	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%	百万円 JPY mil.	%
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	7,285,903	(98.8)	91,146	(1.2)	7,377,049	(100.0)
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	7,844,011	(98.4)	127,808	(1.6)	7,971,820	(100.0)

(2) 設定・交換実績

(千口未満切捨て)

Creation and Exchange

(fractions of less than one thousand units shall be rounded down)

	前計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Previous Fiscal Period (①)	設定口数 No. of Units Created (②)	交換口数 No. of Units Exchanged (③)	当計算期間末 発行済口数 No. of Issued Units at End of Fiscal Period (①+②-③)
	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units	千口 '000 units
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	276,525	16,958	21,953	271,530
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	272,004	33,969	29,449	276,525

(3) 基準価額

Net Asset Value

	総資産 Total Assets (①)	負債 Liabilities (②)	純資産 Net Assets (③(①-②))	10口当り基準価額 ((③/当計算期間末発行済口数)×10) Net Asset Value per 10 units ((③/No. of Issued Units at End of Fiscal Period)×10)
	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	百万円 JPY mil.	円 JPY
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	7,577,131	200,082	7,377,049	271,684
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	8,131,330	159,510	7,971,820	288,285

(4) 分配金

Dividend Payment

	10口当り分配金 Dividend per 10 units
	円 JPY
2022年7月期 FY ended Jul. 2022	4,970
2021年7月期 FY ended Jul. 2021	3,650

2. 会計方針の変更

Change in Accounting Policies

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 Changes accompanying revision to accounting standards, etc. No
- ② ①以外の変更 無
 Changes other than those in ① No

II 財務諸表等 Financial Statements

(1) 【貸借対照表】 Balance Sheet

(単位：円) (Unit: JPY)

	第20期 (2021年7月8日現在) 20th Fiscal Year As of July 8, 2021	第21期 (2022年7月8日現在) 21st Fiscal Year As of July 8, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
資産の部 Assets		
流動資産 Current assets		
コール・ローン Call loans	263,987,838,086	259,822,860,895
株式 Stocks	7,844,011,835,160	7,285,903,128,320
未収配当金 Accrued dividends receivable	7,566,896,000	8,828,927,100
未収利息 Accrued interest	6,619,238	1,036,072
その他未収収益 Other accrued revenue	270,688,993	179,475,268
差入委託証拠金 Margin deposits	15,486,900,736	22,396,432,501
流動資産合計 Total current assets	8,131,330,778,213	7,577,131,860,156
資産合計 Total assets	8,131,330,778,213	7,577,131,860,156
負債の部 Liabilities		
流動負債 Current liabilities		
派生商品評価勘定 Revaluation of derivatives	3,716,125,036	4,089,939,299
未払金 Accounts payable - other	2,914,951,276	6,483,770,641
未払収益分配金 Unpaid dividends	100,931,726,835	134,950,590,908
未払受託者報酬 Trustee fees payable	2,003,236,641	1,858,450,639
未払委託者報酬 Investment trust management fees payable	6,092,241,712	5,586,083,967
未払利息 Accrued interest expenses	197,810	46,056
有価証券貸借取引受入金 Cash collateral received for securities lent	41,847,452,428	44,651,124,942
その他未払費用 Other accrued expenses	2,004,196,824	2,462,078,787
流動負債合計 Total current liabilities	159,510,128,562	200,082,085,239

Total current liabilities		
負債合計 Total liabilities	159,510,128,562	200,082,085,239
純資産の部 Net assets		
元本等 Principal and other		
元本 Principal	3,403,196,608,653	3,341,724,189,748
剰余金 Surplus		
期末剰余金又は期末欠損金 (△) Surplus (deficit) at end of period	4,568,624,040,998	4,035,325,585,169
(分配準備積立金) (Reserve for distribution)	139,761,746	154,469,862
元本等合計 Total principal and other	7,971,820,649,651	7,377,049,774,917
純資産合計 Total net assets	7,971,820,649,651	7,377,049,774,917
負債純資産合計 Total liabilities and net assets	8,131,330,778,213	7,577,131,860,156

(2) 【損益及び剰余金計算書】 Statement of Income and Retained Earnings

(単位：円) (Unit：JPY)

	第20期 自 2020年7月9日 至 2021年7月8日 20th Fiscal Year From July 9, 2020 to July 8, 2021	第21期 自 2021年7月9日 至 2022年7月8日 21st Fiscal Year From July 9, 2021 to July 8, 2022
	金額 Amount	金額 Amount
営業収益 Operating revenue		
受取配当金 Dividend income	117,497,503,148	152,163,042,112
受取利息 Interest income	67,906	93,454
有価証券売買等損益 Profit and loss on buying and selling of securities and other	1,567,555,603,008	△420,972,456,271
派生商品取引等損益 Profit and loss on dealing of derivatives	33,133,711,266	△11,176,220,531
その他収益 Other revenue	1,289,932,436	1,049,375,486
営業収益合計 Total operating revenue	1,719,476,817,764	△278,936,165,750
営業費用 Operating expenses		
支払利息 Interest expenses	△93,283,165	△80,398,011
受託者報酬 Trustee fees	3,730,049,595	3,861,907,284
委託者報酬 Investment trust management fees	11,845,853,774	11,665,528,866

その他費用 Other expenses	2,420,099,336	2,800,173,889
営業費用合計 Total operating expenses	17,902,719,540	18,247,212,028
営業利益又は営業損失(△) Operating profit (loss)	1,701,574,098,224	△297,183,377,778
経常利益又は経常損失(△) Ordinary profit (loss)	1,701,574,098,224	△297,183,377,778
当期純利益又は当期純損失(△) Profit (loss)	1,701,574,098,224	△297,183,377,778
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△) Distribution of profit loss from partial exchange	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△) Surplus (deficit) at beginning of period	2,902,304,770,375	4,568,624,040,998
剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit	517,052,534,060	273,675,962,052
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 Increase in surplus or decrease in deficit from additional subscriptions for period	517,052,534,060	273,675,962,052
剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit	451,375,634,826	374,840,449,195
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 Decrease in surplus or increase in deficit from partial exchange	451,375,634,826	374,840,449,195
分配金 Dividends	100,931,726,835	134,950,590,908
期末剰余金又は期末欠損金(△) Surplus (deficit) at end of period	4,568,624,040,998	4,035,325,585,169

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年7月9日から2022年7

(重要な会計上の見積りに関する注記)
 該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第 20 期 2021年 7月 8日現在	第 21 期 2022年 7月 8日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 276, 525, 279 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 271, 530, 364 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 28, 828. 5 円 (10 口当たり純資産額) (288, 285 円)	2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 27, 168. 4 円 (10 口当たり純資産額) (271, 684 円)
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 39, 079, 532, 330 円	3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 43, 223, 100, 520 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 20 期 自 2020年 7月 9日 至 2021年 7月 8日	第 21 期 自 2021年 7月 9日 至 2022年 7月 8日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>118, 880, 786, 655 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>186, 704, 631 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>119, 067, 491, 286 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>17, 996, 002, 705 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>101, 071, 488, 581 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>100, 931, 726, 835 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>139, 761, 746 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>276, 525, 279 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>3, 650 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	118, 880, 786, 655 円	分配準備積立金	B	186, 704, 631 円	配当等収益合計額	C=A+B	119, 067, 491, 286 円	経費	D	17, 996, 002, 705 円	収益分配可能額	E=C-D	101, 071, 488, 581 円	収益分配金	F	100, 931, 726, 835 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	139, 761, 746 円	口数	H	276, 525, 279 口	10 口当たり分配金	I=F/H×10	3, 650 円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>153, 292, 909, 063 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>139, 761, 746 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>153, 432, 670, 809 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>18, 327, 610, 039 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>135, 105, 060, 770 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>134, 950, 590, 908 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>154, 469, 862 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>271, 530, 364 口</td> </tr> <tr> <td>10 口当たり分配金</td> <td>I=F/H×10</td> <td>4, 970 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	153, 292, 909, 063 円	分配準備積立金	B	139, 761, 746 円	配当等収益合計額	C=A+B	153, 432, 670, 809 円	経費	D	18, 327, 610, 039 円	収益分配可能額	E=C-D	135, 105, 060, 770 円	収益分配金	F	134, 950, 590, 908 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	154, 469, 862 円	口数	H	271, 530, 364 口	10 口当たり分配金	I=F/H×10	4, 970 円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	118, 880, 786, 655 円																																																											
分配準備積立金	B	186, 704, 631 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	119, 067, 491, 286 円																																																											
経費	D	17, 996, 002, 705 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	101, 071, 488, 581 円																																																											
収益分配金	F	100, 931, 726, 835 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	139, 761, 746 円																																																											
口数	H	276, 525, 279 口																																																											
10 口当たり分配金	I=F/H×10	3, 650 円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	153, 292, 909, 063 円																																																											
分配準備積立金	B	139, 761, 746 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	153, 432, 670, 809 円																																																											
経費	D	18, 327, 610, 039 円																																																											
収益分配可能額	E=C-D	135, 105, 060, 770 円																																																											
収益分配金	F	134, 950, 590, 908 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	154, 469, 862 円																																																											
口数	H	271, 530, 364 口																																																											
10 口当たり分配金	I=F/H×10	4, 970 円																																																											
2. その他費用 その他費用のうち 1, 666, 403, 435 円は、対象指数についての商標使用料であります。	2. その他費用 その他費用のうち 2, 165, 325, 229 円は、対象指数についての商標使用料であります。																																																												

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第 20 期 自 2020年 7月 9日 至 2021年 7月 8日	第 21 期 自 2021年 7月 9日 至 2022年 7月 8日
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1. 金融商品に対する取組方針 同左
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。	同左
--	----

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第20期 2021年7月8日現在	第21期 2022年7月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第20期 自2020年7月9日 至2021年7月8日	第21期 自2021年7月9日 至2022年7月8日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第20期 自2020年7月9日 至2021年7月8日	第21期 自2021年7月9日 至2022年7月8日
期首元本額 3,347,558,286,177円	期首元本額 3,403,196,608,653円
期中追加設定元本額 418,067,313,160円	期中追加設定元本額 208,703,952,050円
期中一部交換元本額 362,428,990,684円	期中一部交換元本額 270,176,370,955円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第20期 自2020年7月9日 至2021年7月8日	第21期 自2021年7月9日 至2022年7月8日
	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,421,317,432,826	△435,108,857,206
合計	1,421,317,432,826	△435,108,857,206

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第20期(2021年7月8日現在)				第21期(2022年7月8日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	130,614,093,576	—	126,900,200,000	△3,716,125,036	93,817,190,159	—	89,728,920,000	△4,089,939,299
合計	130,614,093,576	—	126,900,200,000	△3,716,125,036	93,817,190,159	—	89,728,920,000	△4,089,939,299

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年7月8日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	日本水産	9,656,000	567.00	5,474,952,000	
		マルハニチロ	965,600	2,498.00	2,412,068,800	貸付有価証券 3,700株
		I N P E X	3,862,400	1,374.00	5,306,937,600	
		コムシスホールディングス	9,656,000	2,578.00	24,893,168,000	貸付有価証券 2,000株
		大成建設	1,931,200	4,205.00	8,120,696,000	
		大林組	9,656,000	957.00	9,240,792,000	
		清水建設	9,656,000	747.00	7,213,032,000	貸付有価証券 49,700株
		長谷工コーポレーション	1,931,200	1,564.00	3,020,396,800	貸付有価証券 6,100株
		鹿島建設	4,828,000	1,494.00	7,213,032,000	
		大和ハウス工業	9,656,000	3,209.00	30,986,104,000	貸付有価証券 1,900株
		積水ハウス	9,656,000	2,331.00	22,508,136,000	
		日揮ホールディングス	9,656,000	1,649.00	15,922,744,000	貸付有価証券 12,000株
		日清製粉グループ本社	9,656,000	1,634.00	15,777,904,000	貸付有価証券 15,300株
明治ホールディングス	1,931,200	7,010.00	13,537,712,000			

日本ハム	4,828,000	4,300.00	20,760,400,000	
サッポロホールディングス	1,931,200	2,902.00	5,604,342,400	貸付有価証券 23,100株
アサヒグループホールディングス	9,656,000	4,457.00	43,036,792,000	貸付有価証券 53,700株
麒麟ホールディングス	9,656,000	2,175.50	21,006,628,000	貸付有価証券 23,200株
宝ホールディングス	9,656,000	1,011.00	9,762,216,000	
キッコーマン	9,656,000	7,720.00	74,544,320,000	貸付有価証券 9,900株
味の素	9,656,000	3,431.00	33,129,736,000	
ニチレイ	4,828,000	2,416.00	11,664,448,000	
日本たばこ産業	9,656,000	2,342.50	22,619,180,000	貸付有価証券 1,800株
東洋紡	965,600	1,037.00	1,001,327,200	貸付有価証券 2,600株
ユニチカ	965,600	234.00	225,950,400	貸付有価証券 98,400株
帝人	1,931,200	1,419.00	2,740,372,800	
東レ	9,656,000	747.60	7,218,825,600	貸付有価証券 5,700株
王子ホールディングス	9,656,000	563.00	5,436,328,000	
日本製紙	965,600	971.00	937,597,600	貸付有価証券 69,600株
クラレ	9,656,000	1,071.00	10,341,576,000	貸付有価証券 1,600,600株
旭化成	9,656,000	1,055.50	10,191,908,000	貸付有価証券 8,000株
昭和電工	965,600	2,222.00	2,145,563,200	貸付有価証券 1,100株
住友化学	9,656,000	525.00	5,069,400,000	貸付有価証券 2,700株
日産化学	9,656,000	6,510.00	62,860,560,000	貸付有価証券 7,300株
東ソー	4,828,000	1,712.00	8,265,536,000	
トクヤマ	1,931,200	1,752.00	3,383,462,400	
デンカ	1,931,200	3,315.00	6,401,928,000	
信越化学工業	9,656,000	15,980.00	154,302,880,000	
三井化学	1,931,200	2,835.00	5,474,952,000	
三菱ケミカルグループ	4,828,000	744.20	3,592,997,600	貸付有価証券 3,900株
UBE	965,600	2,028.00	1,958,236,800	貸付有価証券 300株
花王	9,656,000	5,708.00	55,116,448,000	

D I C	965,600	2,426.00	2,342,545,600	
富士フイルムホールディングス	9,656,000	7,622.00	73,598,032,000	
資生堂	9,656,000	5,552.00	53,610,112,000	貸付有価証券 500株
日東電工	9,656,000	8,550.00	82,558,800,000	
協和キリン	9,656,000	3,130.00	30,223,280,000	
武田薬品工業	9,656,000	3,884.00	37,503,904,000	
アステラス製薬	48,280,000	2,122.00	102,450,160,000	貸付有価証券 476,300株
住友ファーマ	9,656,000	1,103.00	10,650,568,000	
塩野義製薬	9,656,000	7,063.00	68,200,328,000	
中外製薬	28,968,000	3,657.00	105,935,976,000	
エーザイ	9,656,000	6,096.00	58,862,976,000	
第一三共	28,968,000	3,443.00	99,736,824,000	
大塚ホールディングス	9,656,000	4,879.00	47,111,624,000	
出光興産	3,862,400	3,180.00	12,282,432,000	
E N E O S ホールディングス	9,656,000	499.40	4,822,206,400	
横浜ゴム	4,828,000	1,919.00	9,264,932,000	貸付有価証券 67,800株
ブリヂストン	9,656,000	4,966.00	47,951,696,000	貸付有価証券 1,917,400株
A G C	1,931,200	4,760.00	9,192,512,000	貸付有価証券 1,100株
日本板硝子	965,600	388.00	374,652,800	貸付有価証券 238,400株
日本電気硝子	2,896,800	2,640.00	7,647,552,000	貸付有価証券 72,200株
住友大阪セメント	965,600	3,550.00	3,427,880,000	貸付有価証券 194,600株
太平洋セメント	965,600	1,961.00	1,893,541,600	
東海カーボン	9,656,000	1,033.00	9,974,648,000	貸付有価証券 220,700株
T O T O	4,828,000	4,570.00	22,063,960,000	貸付有価証券 9,000株
日本碍子	9,656,000	1,842.00	17,786,352,000	貸付有価証券 3,700株
日本製鉄	965,600	1,930.00	1,863,608,000	貸付有価証券 15,500株
神戸製鋼所	965,600	617.00	595,775,200	
J F E ホールディングス	965,600	1,468.00	1,417,500,800	貸付有価証券 2,200株
大平洋金属	965,600	2,366.00	2,284,609,600	貸付有価証券

				114,200株
日本軽金属ホールディングス	965,600	1,528.00	1,475,436,800	貸付有価証券 2,500株
三井金属鉱業	965,600	3,095.00	2,988,532,000	貸付有価証券 16,600株
東邦亜鉛	965,600	2,163.00	2,088,592,800	貸付有価証券 114,900株
三菱マテリアル	965,600	1,926.00	1,859,745,600	貸付有価証券 4,200株
住友金属鉱山	4,828,000	4,043.00	19,519,604,000	
DOWAホールディングス	1,931,200	4,500.00	8,690,400,000	貸付有価証券 11,500株
古河電気工業	965,600	2,264.00	2,186,118,400	貸付有価証券 13,400株
住友電気工業	9,656,000	1,457.50	14,073,620,000	貸付有価証券 1,000株
フジクラ	9,656,000	736.00	7,106,816,000	
SUMCO	965,600	1,757.00	1,696,559,200	貸付有価証券 514,400株
日本製鋼所	1,931,200	3,080.00	5,948,096,000	
オークマ	1,931,200	5,100.00	9,849,120,000	
アマダ	9,656,000	1,016.00	9,810,496,000	
小松製作所	9,656,000	2,936.00	28,350,016,000	貸付有価証券 1,000株
住友重機械工業	1,931,200	2,914.00	5,627,516,800	貸付有価証券 71,900株
日立建機	9,656,000	2,865.00	27,664,440,000	貸付有価証券 111,700株
クボタ	9,656,000	2,095.00	20,229,320,000	貸付有価証券 487,500株
荏原製作所	1,931,200	5,080.00	9,810,496,000	貸付有価証券 8,300株
ダイキン工業	9,656,000	22,040.00	212,818,240,000	貸付有価証券 700株
日本精工	9,656,000	723.00	6,981,288,000	貸付有価証券 366,000株
NTN	9,656,000	249.00	2,404,344,000	貸付有価証券 267,000株
ジェイテクト	9,656,000	1,009.00	9,742,904,000	貸付有価証券 52,300株
三井E&Sホールディングス	965,600	334.00	322,510,400	貸付有価証券 143,500株
日立造船	1,931,200	843.00	1,628,001,600	
三菱重工業	965,600	5,014.00	4,841,518,400	
IHI	965,600	3,535.00	3,413,396,000	貸付有価証券 3,200株

コニカミノルタ	9,656,000	456.00	4,403,136,000	
ミネベアミツミ	9,656,000	2,329.00	22,488,824,000	貸付有価証券 7,500株
日立製作所	1,931,200	6,490.00	12,533,488,000	貸付有価証券 26,200株
三菱電機	9,656,000	1,454.50	14,044,652,000	
富士電機	1,931,200	5,450.00	10,525,040,000	
安川電機	9,656,000	4,545.00	43,886,520,000	貸付有価証券 11,900株
オムロン	9,656,000	7,001.00	67,601,656,000	貸付有価証券 16,800株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,931,200	2,203.00	4,254,433,600	貸付有価証券 6,100株
日本電気	965,600	5,500.00	5,310,800,000	貸付有価証券 9,700株
富士通	965,600	17,890.00	17,274,584,000	
沖電気工業	965,600	743.00	717,440,800	貸付有価証券 18,500株
セイコーエプソン	19,312,000	1,931.00	37,291,472,000	貸付有価証券 24,000株
パナソニック ホールディングス	9,656,000	1,125.00	10,863,000,000	
シャープ	9,656,000	1,058.00	10,216,048,000	貸付有価証券 4,163,900株 (42,800 株)
ソニーグループ	9,656,000	11,145.00	107,616,120,000	貸付有価証券 300株
TDK	28,968,000	4,050.00	117,320,400,000	貸付有価証券 120,400株
アルプスアルパイン	9,656,000	1,308.00	12,630,048,000	貸付有価証券 533,700株
横河電機	9,656,000	2,209.00	21,330,104,000	
アドバンテスト	19,312,000	7,280.00	140,591,360,000	
キーエンス	965,600	49,630.00	47,922,728,000	
カシオ計算機	9,656,000	1,257.00	12,137,592,000	貸付有価証券 236,300株
ファナック	9,656,000	21,905.00	211,514,680,000	貸付有価証券 800株
京セラ	19,312,000	6,929.00	133,812,848,000	
太陽誘電	9,656,000	4,565.00	44,079,640,000	貸付有価証券 27,300株
村田製作所	7,724,800	7,616.00	58,832,076,800	貸付有価証券 600株
S C R E E Nホールディ ングス	1,931,200	9,000.00	17,380,800,000	
キャノン	14,484,000	3,100.00	44,900,400,000	貸付有価証券

				124,800株
リコー	9,656,000	1,042.00	10,061,552,000	貸付有価証券 7,700株
東京エレクトロン	9,656,000	43,550.00	420,518,800,000	貸付有価証券 200株
デンソー	9,656,000	7,280.00	70,295,680,000	
川崎重工業	965,600	2,491.00	2,405,309,600	貸付有価証券 2,200株
日産自動車	9,656,000	504.20	4,868,555,200	
いすゞ自動車	4,828,000	1,451.00	7,005,428,000	貸付有価証券 5,400株
トヨタ自動車	48,280,000	2,111.00	101,919,080,000	
日野自動車	9,656,000	711.00	6,865,416,000	貸付有価証券 7,600株
三菱自動車工業	965,600	420.00	405,552,000	貸付有価証券 90,700株 (18,800 株)
マツダ	1,931,200	1,020.00	1,969,824,000	
本田技研工業	19,312,000	3,250.00	62,764,000,000	貸付有価証券 142,900株
スズキ	9,656,000	4,240.00	40,941,440,000	貸付有価証券 30,400株
S U B A R U	9,656,000	2,253.00	21,754,968,000	
ヤマハ発動機	9,656,000	2,505.00	24,188,280,000	貸付有価証券 242,900株
テルモ	38,624,000	4,167.00	160,946,208,000	
ニコン	9,656,000	1,439.00	13,894,984,000	貸付有価証券 3,300株
オリンパス	38,624,000	2,705.50	104,497,232,000	
シチズン時計	9,656,000	529.00	5,108,024,000	
バンダイナムコホールディングス	9,656,000	9,947.00	96,048,232,000	
凸版印刷	4,828,000	2,190.00	10,573,320,000	貸付有価証券 2,400株
大日本印刷	4,828,000	2,819.00	13,610,132,000	
ヤマハ	9,656,000	5,630.00	54,363,280,000	貸付有価証券 6,600株
任天堂	965,600	57,960.00	55,966,176,000	貸付有価証券 1,000株
東京電力ホールディングス	965,600	619.00	597,706,400	貸付有価証券 2,000株
中部電力	965,600	1,378.00	1,330,596,800	貸付有価証券 19,800株
関西電力	965,600	1,375.00	1,327,700,000	貸付有価証券 4,300株

東京瓦斯	1,931,200	2,510.00	4,847,312,000	
大阪瓦斯	1,931,200	2,408.00	4,650,329,600	
東武鉄道	1,931,200	2,974.00	5,743,388,800	貸付有価証券 1,900株
東急	4,828,000	1,528.00	7,377,184,000	
小田急電鉄	4,828,000	1,791.00	8,646,948,000	貸付有価証券 2,300株
京王電鉄	1,931,200	4,800.00	9,269,760,000	
京成電鉄	4,828,000	3,430.00	16,560,040,000	貸付有価証券 141,100株
東日本旅客鉄道	965,600	6,594.00	6,367,166,400	
西日本旅客鉄道	965,600	4,688.00	4,526,732,800	貸付有価証券 900株
東海旅客鉄道	965,600	14,860.00	14,348,816,000	
ヤマトホールディングス	9,656,000	2,257.00	21,793,592,000	貸付有価証券 8,700株
NIPPON EXPRESS ホールディング	965,600	7,520.00	7,261,312,000	
日本郵船	965,600	9,340.00	9,018,704,000	貸付有価証券 55,600株
商船三井	2,896,800	3,130.00	9,066,984,000	貸付有価証券 79,700株
川崎汽船	965,600	7,930.00	7,657,208,000	貸付有価証券 143,500株
ANAホールディングス	965,600	2,422.50	2,339,166,000	貸付有価証券 581,600株
三菱倉庫	4,828,000	3,340.00	16,125,520,000	貸付有価証券 2,300株
ネクソン	19,312,000	2,940.00	56,777,280,000	
Zホールディングス	3,862,400	435.50	1,682,075,200	
トレンドマイクロ	9,656,000	7,280.00	70,295,680,000	貸付有価証券 200株
日本電信電話	3,862,400	3,830.00	14,792,992,000	貸付有価証券 2,200株
KDDI	57,936,000	4,293.00	248,719,248,000	貸付有価証券 2,400株
ソフトバンク	9,656,000	1,525.00	14,725,400,000	
東宝	965,600	4,915.00	4,745,924,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	48,280,000	1,954.00	94,339,120,000	貸付有価証券 12,300株
コナミグループ	9,656,000	7,140.00	68,943,840,000	貸付有価証券 16,000株
ソフトバンクグループ	57,936,000	5,400.00	312,854,400,000	
双日	965,600	1,927.00	1,860,711,200	貸付有価証券 60,000株

伊藤忠商事	9,656,000	3,803.00	36,721,768,000	
丸紅	9,656,000	1,183.50	11,427,876,000	貸付有価証券 6,900株
豊田通商	9,656,000	4,375.00	42,245,000,000	
三井物産	9,656,000	2,851.50	27,534,084,000	
住友商事	9,656,000	1,853.00	17,892,568,000	
三菱商事	9,656,000	3,885.00	37,513,560,000	
J. フロント リテイ リング	4,828,000	1,041.00	5,025,948,000	
三越伊勢丹ホールディ ングス	9,656,000	986.00	9,520,816,000	
セブン&アイ・ホールデ ィングス	9,656,000	5,325.00	51,418,200,000	
高島屋	4,828,000	1,337.00	6,455,036,000	貸付有価証券 46,000株
丸井グループ	9,656,000	2,232.00	21,552,192,000	貸付有価証券 60,700株
イオン	9,656,000	2,624.50	25,342,172,000	貸付有価証券 112,500株
ファーストリテイリング	9,656,000	68,260.00	659,118,560,000	貸付有価証券 95,400株
コンコルディア・フィナ ンシャルグループ	9,656,000	451.00	4,354,856,000	
あおぞら銀行	965,600	2,678.00	2,585,876,800	
三菱UFJフィナンシャ ル・グループ	9,656,000	724.60	6,996,737,600	
りそなホールディングス	965,600	503.70	486,372,720	
三井住友トラスト・ホー ルディングス	965,600	4,198.00	4,053,588,800	貸付有価証券 900株
三井住友フィナンシャル グループ	965,600	4,064.00	3,924,198,400	
千葉銀行	9,656,000	733.00	7,077,848,000	貸付有価証券 18,900株
ふくおかフィナンシャル グループ	1,931,200	2,375.00	4,586,600,000	
静岡銀行	9,656,000	808.00	7,802,048,000	貸付有価証券 88,600株
みずほフィナンシャルグ ループ	965,600	1,559.00	1,505,370,400	
大和証券グループ本社	9,656,000	617.60	5,963,545,600	貸付有価証券 16,500株
野村ホールディングス	9,656,000	506.00	4,885,936,000	貸付有価証券 8,900株
松井証券	9,656,000	801.00	7,734,456,000	貸付有価証券 7,600株
SOMPOホールディ ングス	1,931,200	5,923.00	11,438,497,600	

MS & ADインシュアランスグループホール	2,896,800	4,257.00	12,331,677,600	貸付有価証券 2,400株
第一生命ホールディングス	965,600	2,403.00	2,320,336,800	
東京海上ホールディングス	4,828,000	7,959.00	38,426,052,000	貸付有価証券 800株
T & Dホールディングス	1,931,200	1,595.00	3,080,264,000	
クレディセゾン	9,656,000	1,532.00	14,792,992,000	
オリックス	9,656,000	2,265.00	21,870,840,000	貸付有価証券 6,900株
日本取引所グループ	9,656,000	2,091.00	20,190,696,000	貸付有価証券 15,800株
東急不動産ホールディングス	9,656,000	695.00	6,710,920,000	
三井不動産	9,656,000	2,848.00	27,500,288,000	
三菱地所	9,656,000	1,943.50	18,766,436,000	
東京建物	4,828,000	1,930.00	9,318,040,000	貸付有価証券 11,300株
住友不動産	9,656,000	3,441.00	33,226,296,000	貸付有価証券 1,900株
エムスリー	23,174,400	4,136.00	95,849,318,400	貸付有価証券 15,300株
ディー・エヌ・エー	2,896,800	1,878.00	5,440,190,400	貸付有価証券 2,400株
電通グループ	9,656,000	4,160.00	40,168,960,000	貸付有価証券 109,300株
サイバーエージェント	7,724,800	1,359.00	10,498,003,200	貸付有価証券 6,200株
楽天グループ	9,656,000	637.00	6,150,872,000	貸付有価証券 7,893,900株
リクルートホールディングス	28,968,000	4,242.00	122,882,256,000	
日本郵政	9,656,000	973.60	9,401,081,600	貸付有価証券 1,200株
セコム	9,656,000	8,657.00	83,591,992,000	貸付有価証券 400株
小計	銘柄数：225 組入時価比率：98.8%		7,285,903,128,320 100.0%	
合計			7,285,903,128,320	

(注1) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2) 備考欄の貸付有価証券の()内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(2022年7月8日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。